

УДК 336.76

ПРОГНОЗИРОВАНИЕ ИЗМЕНЕНИЙ КУРСА ДОЛЛАРА ПО ВОЛНАМ ЭЛЛИОТТА

Ущина Е. А., Кореева Е. Б.

Самарский государственный аэрокосмический университет имени академика
С. П. Королёва (национальный исследовательский университет), г. Самара

Данные тезисы содержат основные положения волновой теории Эллиотта. На их основе проанализирован график курса американской валюты и составлен прогноз его изменения на ближайшее время.

Цель данной работы: проанализировать курс доллара за три недели, сопоставив график валюты и волновую структуру выбранной теории; полученные выводы использовать в прогнозе на ближайшую после основного срока неделю; сравнить данные прогноза и реальную статистику.

На современных финансовых рынках наблюдается многообразие используемых инструментов, один из которых – волновая теория Эллиотта. Её основоположником является Ральф Нельсон Эллиотт. Изучив графики длиной от получаса до года, в сумме охватывающие около 75 лет, американский финансист пришел к выводу, что в основе рыночного ценообразования лежит модель под названием «53». Она представляет собой полный цикл, состоящий из восьми волн – пяти волн главной тенденции (три импульсные и две корректирующие) и трёх волн её коррекции. Главная тенденция, формируемая волнами 1-5, может быть как восходящей, так и нисходящей, а волны А, В и С всегда находятся в противодействии волнам 1-5.

В основе волновой теории Эллиотта лежат числа Фибоначчи. Полный набор волн любого цикла является одним из элементов ряда Фибоначчи.

Доказательство тому представлены на рисунке 2: он представляет собой две основные волны (импульсная и корректирующая), восемь промежуточных волн (последовательность «53», показанная на первом графике), а также тринадцать и восемь малых волн, образующих основные. Числа 2, 8, 13 и 21 (сумма всех малых волн) являются членами последовательности Фибоначчи.

Весь полный цикл охватывает временные рамки как с нескольких минут и часов, так и до десятков лет. В этом и состоит отличие Теории Волн от большинства механических систем и методов анализа. Причем изучать можно все периоды одновременно, что позволяет принимать решения с учётом их взаимодействия, тем самым обеспечивая более выгодные условия для прибыли. Но для этой конкретной работы был выбран срок двадцать один день ввиду его средней продолжительности.

Был взят курс доллара США в период с 21 марта по 13 апреля 2015 года. На графике, отражающем изменение валюты за этот срок, главной тенденцией является падение доллара по отношению к рублю. При его детальном изучении было решено принять первый день выбранного периода (т.е. 21 марта) за начало первой волны Эллиотта, после чего отчетливо прослеживается, что самая длинная третья волна заканчивается 11 апреля. Волновая теория гласит, что 4 и 5 волны не продолжительны, следовательно, можно составить такой прогноз, что главная тенденция закончится через 5-7 дней после конца третьей волны (вывод сделан на основе длительности первых двух волн).

Произведено соотношение волновой модели «53» с текущими данными. Придя к выводу о том, что главная тенденция близилась к окончанию, можно сказать о росте валюты в ближайшие семь дней (взяла начало коррекционная волна). Стоит ожидать

рост американской валюты по отношению к отечественной на несколько российских денежных единиц.

После анализа котировок в течение недели шло наблюдение за изменениями курса. Гипотеза, выдвинутая ранее в данной статье, подтвердилась. По прошествии шести дней на графике отразились волны коррекции главной тенденции.

Из проведённого исследования можно сделать вывод, что основа теории волн Эллиотта проста, но само использование её на рынке считается одним из самых сложных и всеобъемлющих методов анализа, так как процесс достижения совершенства в этой области достаточно затяжной и требующий практики. Данную теорию применяют не только на фондовых рынках, но и в недвижимости, рынках товаров и услуг, товарных фьючерсах и т.д. Главное, что должно при этом выполняться – точные и согласующиеся данные. Это и стало фактором успешного прогноза в данной статье.

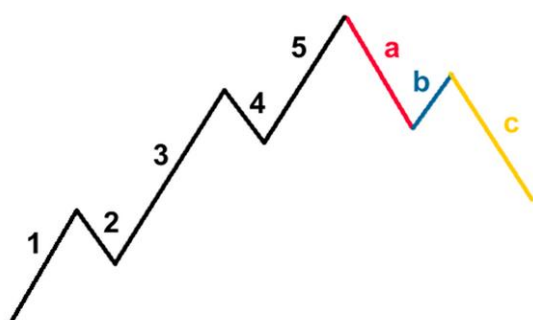


Рис. 1 Полный цикл волновой модели «53»

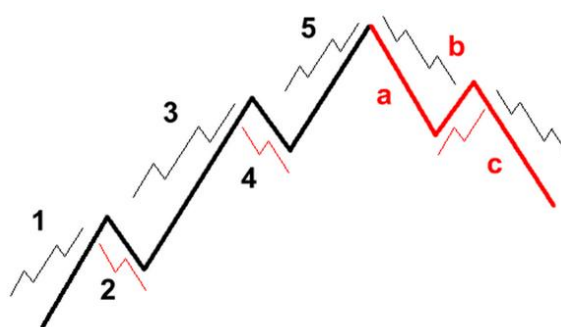


Рис. 2 Составление цикла из подциклов

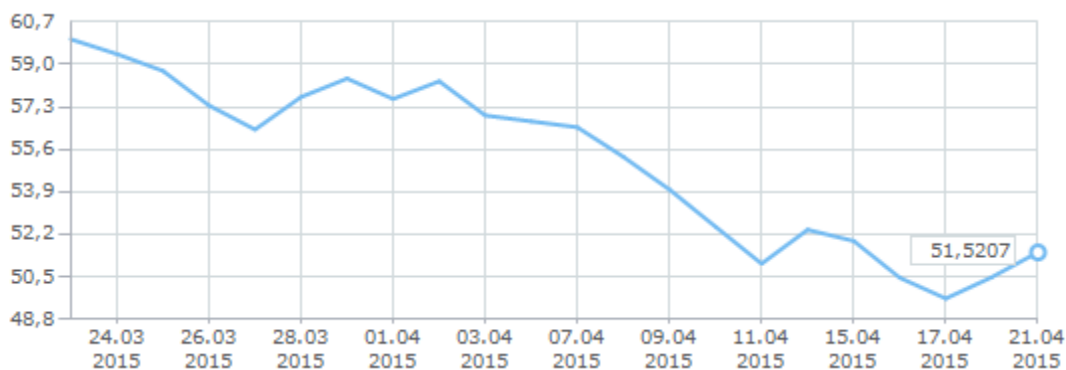


Рис. 3 Курс доллара США в период с 21 марта по 21 апреля

Библиографический список:

1. Нили, Г. Мастерство анализа волн Эллиота [Текст]/ Г. Нили. – М.: ИК "Аналитика", 2002. – 325 с.
2. Джозеф, Т. Упрощённый анализ волны Эллиотта. Практическое применение механической системы торговли [Текст]/ Т. Джозеф. – М.: 2000. – 80 с.